

信息披露 disclosure

金鹰中小盘精选证券投资基金

2014 半年度报告摘要

投资基金的半年度报告中财务数据、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
交易性金融资产	6.4.7.1	32,212,427.32	17,091,199.08
买入返售金融资产		89,323,635.36	43,213,164.78
存出保证金		434,698.06	445,582.52
交易性金融资产	6.4.7.2	1,181,873,748.03	1,421,821,305.29
其中：股票投资		914,641,700.03	1,055,523,119.29
基金投资		-	-
债券投资		267,320,048.00	366,288,186.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	70,350,345.53
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	29,857,681.75
应收证券清算款		-	7,089,933.98
应收利息	6.4.7.5	17,089,933.98	6,843,959.93
应收股利		-	-
应收申购款		162,300.53	481,480.13
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,311,096,743.28	1,590,104,719.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,424,982.41	2,694,269.66
应付管理人报酬		1,599,985.94	1,830,318.87
应付托管费		266,664.29	305,053.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费	6.4.7.6	428,072.47	1,299,437.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,450,993.96	1,382,480.45
负债合计		6,170,609.07	7,511,559.94
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.8	1,539,672,458.14	1,980,734,456.70
未分配利润	6.4.7.9	-234,746,413.93	-398,141,297.63
所有者权益合计		1,304,926,044.21	1,582,593,159.07
负债和所有者权益总计		1,311,096,743.28	1,590,104,719.01

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.8475元，基金份额总额1,539,672,458.14份。

资产	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		104,465,309.12	163,984,444.25
1.利息收入		8,998,836.39	8,459,860.91
其中：存款利息收入	6.4.7.10	339,580.73	584,143.17
债券利息收入		7,813,648.31	7,247,369.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		845,607.35	628,348.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”号填列）		19,061,285.03	26,957,663.02
其中：股票投资收益	6.4.7.11	33,423,696.94	22,112,538.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-17,308,415.08	5,599.97
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.13	2,946,003.17	4,839,524.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	75,995,911.03	128,342,562.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	409,276.67	224,357.99
减：二、费用		14,838,476.35	20,150,527.58
1.管理人报酬		10,817,082.38	11,141,343.00
2.托管费		1,802,847.00	1,901,890.52
3.其他费用		-	-
4.交易费用	6.4.7.16	2,033,112.99	6,660,430.73
5.利息支出		2,860.19	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,860.19	-
6.其他费用	6.4.7.17	182,573.79	187,863.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		89,626,832.77	143,879,916.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		89,626,832.77	143,879,916.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表
基金管理人金鹰基金管理有限公司
报告截止日：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益（基金净值）	1,980,734,456.70	-398,141,297.63	1,582,593,159.07
一、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	89,626,832.77	89,626,832.77
二、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-441,061,998.56	73,768,050.93	-367,293,947.63
其中：1.基金申购款	53,265,948.40	-9,320,354.88	43,945,593.52
2.基金赎回款	-494,327,946.96	83,088,405.81	-411,239,541.15
三、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,539,672,458.14	-234,746,413.93	1,304,926,044.21
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,212,466,702.91	-629,438,624.62	1,493,028,078.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	143,879,916.67	143,879,916.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-201,704,739.08	46,778,203.65	-154,926,535.43
其中：1.基金申购款	125,613,999.63	-30,891,157.05	94,722,842.58
2.基金赎回款	-327,318,738.71	77,669,360.70	-249,649,378.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,920,761,963.83	-438,780,504.30	1,481,981,459.53

报告期末资产负债表科目余额表
基金管理人金鹰基金管理有限公司
报告截止日：2014年6月30日

项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,212,466,702.91	-629,438,624.62	1,493,028,078.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	143,879,916.67	143,879,916.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-201,704,739.08	46,778,203.65	-154,926,535.43
其中：1.基金申购款	125,613,999.63	-30,891,157.05	94,722,842.58
2.基金赎回款	-327,318,738.71	77,669,360.70	-249,649,378.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,920,761,963.83	-438,780,504.30	1,481,981,459.53

6.4 财务报表的编制基础
基金管理人金鹰基金管理有限公司
报告截止日：2014年6月30日

项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,212,466,702.91	-629,438,624.62	1,493,028,078.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	143,879,916.67	143,879,916.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-201,704,739.08	46,778,203.65	-154,926,535.43
其中：1.基金申购款	125,613,999.63	-30,891,157.05	94,722,842.58
2.基金赎回款	-327,318,738.71	77,669,360.70	-249,649,378.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,920,761,963.83	-438,780,504.30	1,481,981,459.53

6.5 会计政策和会计估计
基金管理人金鹰基金管理有限公司
报告截止日：2014年6月30日

项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,212,466,702.91	-629,438,624.62	1,493,028,078.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	143,879,916.67	143,879,916.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-201,704,739.08	46,778,203.65	-154,926,535.43
其中：1.基金申购款	125,613,999.63	-30,891,157.05	94,722,842.58
2.基金赎回款	-327,318,738.71	77,669,360.70	-249,649,378.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,920,761,963.83	-438,780,504.30	1,481,981,459.53

6.6 管理人和托管人
基金管理人金鹰基金管理有限公司
报告截止日：2014年6月30日

项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,212,466,702.91	-629,438,624.62	1,493,028,078.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	143,879,916.67	143,879,916.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-201,704,739.08	46,778,203.65	-154,926,535.43
其中：1.基金申购款	125,613,999.63	-30,891,157.05	94,722,842.58
2.基金赎回款	-327,318,738.71	77,669,360.70	-249,649,378.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,920,761,963.83	-438,780,504.30	1,481,981,459.53

6.4.8.1.1 股票交易

基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期股票成交总额的比例	-	-

注：本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出股票。

6.4.8.1.2 权证交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期权证成交总额的比例	-	-

6.4.8.2 关联方债券
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券成交总额的比例	-	-

注：本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出债券。

6.4.8.1.4 债券回购交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券回购成交总额的比例	-	-

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
佣金	-	-
占当期佣金总额的比例	-	-

注：1、本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出股票。

6.4.8.1.6 权证交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期权证成交总额的比例	-	-

6.4.8.2 关联方债券
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券成交总额的比例	-	-

注：1、本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出债券。

6.4.8.2.1 债券回购交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券回购成交总额的比例	-	-

6.4.8.2.2 应支付关联方的佣金
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
佣金	-	-
占当期佣金总额的比例	-	-

注：1、本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出股票。

6.4.8.2.3 债券回购交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券回购成交总额的比例	-	-

6.4.8.2.4 应支付关联方的佣金
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
佣金	-	-
占当期佣金总额的比例	-	-

注：1、本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出股票。

6.4.8.2.5 债券回购交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券回购成交总额的比例	-	-

6.4.8.2.6 应支付关联方的佣金
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
佣金	-	-
占当期佣金总额的比例	-	-

注：1、本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出股票。

6.4.8.2.7 债券回购交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券回购成交总额的比例	-	-

6.4.8.2.8 应支付关联方的佣金
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
佣金	-	-
占当期佣金总额的比例	-	-

注：1、本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出股票。

6.4.8.2.9 债券回购交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
成交金额	-	-
占当期债券回购成交总额的比例	-	-

6.4.8.2.10 应支付关联方的佣金
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
佣金	-	-
占当期佣金总额的比例	-	-

注：1、本基金报告期内未通过关联方交易买入或卖出股票。

6.4.8.2.11 债券回购交易
基金管理人金鹰基金管理有限公司
基金托管人交通银行股份有限公司
报告截止日：2014年6月30日